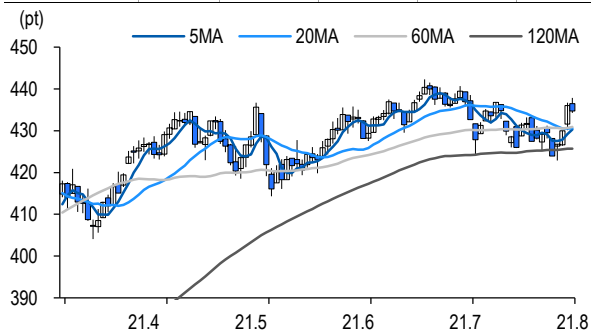


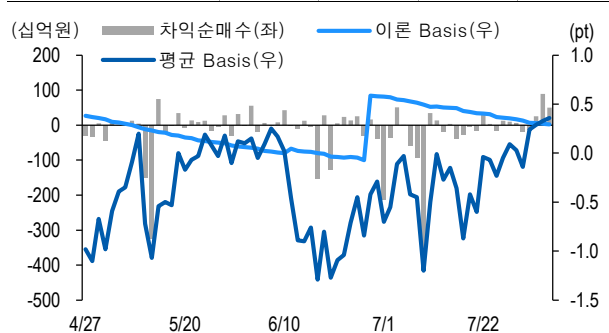
선물옵션시장 지표

2021.8.6

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	434.74	-0.30	-1.31	8,884.4	-
선물 9월물	435.20	-0.23	-1.00	24,070.7	257,564
선물 12월물	435.15	-0.14	-0.60	69.7	29,620
8월물(mini)	435.14	-0.23	-1.00	2,348.2	89,299
9월물(mini)	435.48	-0.17	-1.02	11.7	21,423



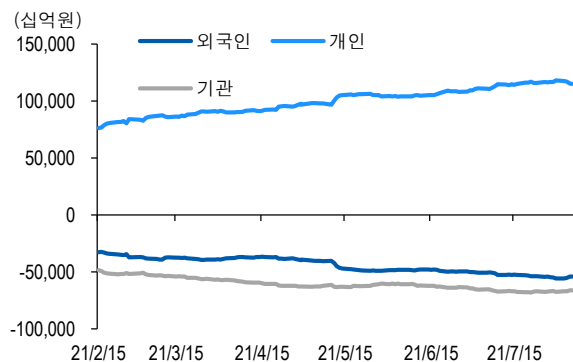
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.29	0.36	0.46	0.02%
베이스(mini)	0.06	0.24	0.40	0.04%
제1스프레드(SP)	0.16	-0.46	-0.50	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.06	0.52	0.52	0.11%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	69.6	31.2	100.8	7.8	-262.7	-121.8	-157.8	12.4	1.6	-18.2
개인	-255.8	37.5	-218.3	0.0	-3.1	530.2	50.2	-14.0	-1.9	27.8
기관	186.1	-70.7	115.5	41.9	-57.8	-444.6	108.6	1.3	1.0	-8.0
금융투자	385.0	43.9	428.9	25.3	32.3	-63.3	108.6	0.4	0.9	24.6
투신	6.8	-34.7	-27.9	2.2	-3.4	-400.0	-0.2	0.9	-0.1	-42.6
은행+보험+기타금융	-25.2	-39.0	-64.2	0.0	-7.8	24.5	0.0	0.0	0.2	-0.2
연기금+국가지자체	-154.8	-0.2	-155.0	4.5	-90.9	-5.9	0.1	0.0	0.0	10.2
기타법인	0.1	2.0	2.0	0.0	-5.3	36.3	-1.0	0.4	-0.7	-1.6

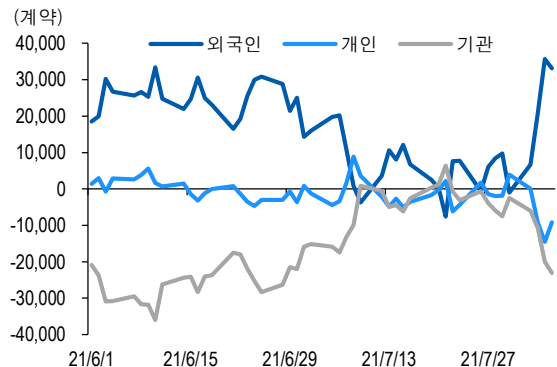
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,095,054	299.6	900,138	12.5%	지수옵션 전체	2,212,546	559.4	2,511,210
Put	1,117,492	259.8	1,611,072	12.6%	PCR(금액기준)	0.87	VKOSPI	14.53%(-0.24%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	442.5(K+3)	0.70	-0.37	178,341	30,139	922	12.2	Put	437.5(K+1)	4.35	0.23	21,600	4,665	1,599	10.9
	440.0(K+2)	1.30	-0.51	154,926	34,570	-3,999	12.6		435.0(K+0)	2.98	-0.03	68,065	13,768	3,972	11.2
	437.5(K+1)	2.11	-0.68	92,341	24,204	1,311	12.7		432.5(K-1)	2.06	-0.05	97,331	12,014	2,285	12.0
	435.0(K+0)	3.24	-0.85	45,319	23,121	-348	13.0		430.0(K-2)	1.40	-0.10	150,971	25,482	2,335	12.7
	432.5(K-1)	4.74	-1.05	8,043	16,750	95	13.5		427.5(K-3)	0.92	-0.16	126,698	21,945	3,797	13.3

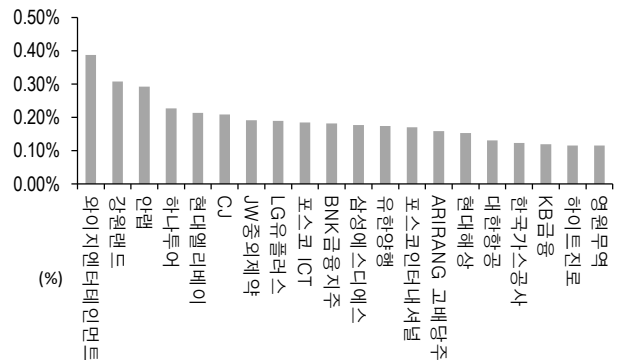
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)

										(계약, 십억원)	
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	
주식선물 전체	3,543,685	3,436.7	6,839,228	31,253	-34,415	42,243	-554	-18.2	27.8	-8.0	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
하나금융지주	43,500	-1.14	27.9	95.0	94,609	-1,348	0.02%	-6,680	2,967	3,707	1,657	2,008
SK 텔레콤	306,000	-0.49	29.2	77.1	18,810	1,262	0.00%	-502	1,610	-1,108	-71	-1,020
삼성전자	82,300	-0.72	1,165.3	76.8	1,097,743	-48,317	0.05%	-6,771	17,204	-9,882	2,416	-15,940
NAVER	443,000	2.07	252.9	76.6	81,755	189	0.00%	-453	185	316	945	23
SK 하이닉스	120,000	-1.23	298.5	71.6	160,475	-6,973	-0.04%	5,368	8,767	-14,137	-2,682	3,421
LG 화학	858,000	0.23	114.6	71.4	15,922	-87	-0.03%	-39	-327	365	-62	428
롯데케미칼	268,000	-0.74	19.2	71.2	11,771	203	-0.13%	-898	457	501	618	1,641
호텔신라	93,900	-0.42	12.3	68.4	21,518	7	0.01%	-1,015	1,043	-28	-32	4
KT	33,550	-0.30	12.6	67.0	74,317	1,089	0.06%	3,809	914	-4,723	-3,498	-1,225
POSCO	344,500	-0.58	85.8	63.5	17,772	917	0.03%	1,554	-146	-1,380	200	-1,334

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터